

**中国期货监控交易报告库  
( CFMMC-TR ) 数据报送手册**

**中国期货市场监控中心  
China Futures Market Monitoring Center**

**2022 年 8 月**

## 修订记录

修订日期	版本号	修订内容
2022年5月	V1.0	首次编制
2022年8月	V1.1	① “19.资产类型”增加“O（其他）”选项； ② “31.期权产品结构”增加“GSA：看涨自动赎回-小雪球/保本雪球”选项； ③增加3个常见问题及解答。

# 目录

一、信息报送总体要求.....	- 1 -
(一) 报告主体.....	- 1 -
(二) 报送范围.....	- 1 -
(三) 报送文件.....	- 1 -
(四) 报送时限.....	- 2 -
二、成交文件、持仓文件的字段解释及填报要求.....	- 2 -
(一) 交易对手方相关字段.....	- 2 -
1. 交易对手方 2 名称.....	- 2 -
2. 交易对手方 2 的统一社会信用代码.....	- 3 -
3. 交易对手方 2 的 LEI.....	- 3 -
4. 主协议类型.....	- 3 -
5. 主协议日期.....	- 4 -
(二) 交易类型相关字段.....	- 4 -
6. 交易类型.....	- 4 -
(三) 清算、交易相关字段.....	- 5 -
7. 是否中央对手方清算.....	- 5 -
8. 中央清算平台名称.....	- 5 -
9. 交易平台.....	- 5 -
(四) 交易编码相关字段.....	- 6 -
10. 交易确认书编号.....	- 6 -
11. 成交编号.....	- 6 -
12. 持仓编号.....	- 6 -
13. 多腿编号.....	- 7 -
(五) 时间相关字段.....	- 7 -
14. 交易确认日期 (开仓).....	- 7 -
15. 生效日.....	- 7 -

16. 到期日 .....	- 8 -
17. 提前终止日期 .....	- 8 -
(六) 产品及标的基本信息相关字段 .....	- 8 -
18. 交易对手方 1 方向 .....	- 8 -
19. 资产类型 .....	- 9 -
20. 工具类型 .....	- 9 -
21. 标的资产所属板块 .....	- 10 -
22. 标的资产品种 .....	- 10 -
23. 标的资产对应合约 .....	- 12 -
24. 标的期初价格 .....	- 14 -
25. 标的期初价格货币 .....	- 14 -
26. 标的期初价格符号 .....	- 14 -
27. 平仓或终止时的标的价格 .....	- 15 -
(七) 期权产品基本信息相关字段 .....	- 15 -
28. 期权行权时间类型 .....	- 15 -
29. 期权权利类型 .....	- 16 -
30. 行权日 .....	- 16 -
31. 期权产品结构 .....	- 16 -
32. 执行价格 1 .....	- 25 -
33. 执行价格 2 .....	- 25 -
34. 执行价格 3 .....	- 26 -
35. 执行价格货币 .....	- 26 -
36. 执行价格符号 .....	- 26 -
37. 观察类型 .....	- 26 -
38. 观察起始日 .....	- 27 -
39. 观察结束日 .....	- 28 -
40. 观察周期 .....	- 28 -
41. 观察周期乘数 .....	- 29 -

42. 收益计算方式.....	- 30 -
43. 保底收益.....	- 31 -
44. 保底收益货币.....	- 31 -
45. 保底收益符号.....	- 31 -
46. 是否已敲入.....	- 32 -
(八) 亚式期权相关字段.....	- 32 -
47. 估值时已观察均值.....	- 32 -
(九) 二元、区间累计期权相关字段.....	- 32 -
48. 行权收益 1.....	- 32 -
49. 行权收益 2.....	- 33 -
50. 行权收益 3.....	- 33 -
51. 行权收益货币.....	- 33 -
52. 行权收益符号.....	- 33 -
(十) 单鲨、双鲨、单障碍敲入期权相关字段.....	- 34 -
53. 障碍价 1.....	- 34 -
54. 障碍价 1 触碰方向.....	- 35 -
55. 障碍价 1 类型.....	- 35 -
56. 障碍价 2.....	- 35 -
57. 障碍价 2 触碰方向.....	- 35 -
58. 障碍价 2 类型.....	- 35 -
59. 补偿收益 1.....	- 36 -
60. 补偿收益 2.....	- 36 -
61. 补偿收益货币.....	- 36 -
62. 补偿收益符号.....	- 36 -
(十一) 雪球、凤凰期权相关字段.....	- 37 -
63. SA&PA-敲入障碍价.....	- 37 -
64. SA&PA-敲入观察期.....	- 37 -
65. SA&PA-敲出障碍价.....	- 38 -

66. SA&PA-Coupon 障碍价.....	- 38 -
67. SA&PA-Coupon 年化收益率.....	- 38 -
(十二) 远期交易相关字段.....	- 38 -
68. 远期价格.....	- 38 -
69. 远期价格货币.....	- 39 -
70. 远期价格符号.....	- 39 -
(十三) 互换交易相关字段.....	- 39 -
71. 固定收益.....	- 39 -
72. 固定收益货币.....	- 39 -
73. 固定收益符号.....	- 39 -
74. 浮动方方向.....	- 40 -
75. 支付周期.....	- 40 -
76. 支付周期乘数.....	- 40 -
(十四) 名义金额、名义数量相关字段.....	- 41 -
77. 初始名义金额.....	- 41 -
78. 交易名义金额.....	- 41 -
79. 已平仓总名义金额.....	- 41 -
80. 外汇兑人民币期初汇率.....	- 42 -
81. 初始名义数量.....	- 43 -
82. 交易名义数量.....	- 43 -
83. 已平仓总名义数量.....	- 43 -
84. 数量单位.....	- 45 -
85. 是否为年化名义金额.....	- 45 -
86. 参与率.....	- 46 -
(十五) 估值相关字段.....	- 46 -
87. 合约估值时标的价格.....	- 46 -
88. 合约价值.....	- 47 -
89. 估值方法.....	- 47 -

90. 估值波动率.....	- 48 -
91. 一年有效天数.....	- 48 -
92. Delta.....	- 48 -
93. Gamma.....	- 48 -
94. Vega.....	- 49 -
95. Theta.....	- 49 -
96. Rho.....	- 49 -
97. Delta cash.....	- 49 -
98. Gamma cash.....	- 50 -
99. 无风险利率.....	- 52 -
100. 股息.....	- 53 -
(十六) 结算相关字段.....	- 53 -
101. 结算方式.....	- 53 -
102. 最后结算日.....	- 53 -
103. 权利金收支或结算收益.....	- 53 -
<b>三、常见问题及解答.....</b>	<b>- 53 -</b>
<b>Q1.已完成场外衍生品业务备案，尚未开展交易，如何报送数据？.....</b>	<b>- 53 -</b>
<b>Q2.被暂停新增场外衍生品业务，如何报送数据？.....</b>	<b>- 54 -</b>
<b>Q3.风险管理公司现货团队开展的场外衍生品交易是否报送？.....</b>	<b>- 54 -</b>
<b>Q4.文件命名有何要求？.....</b>	<b>- 54 -</b>
<b>Q5.若发现历史报送数据出现错误怎么办？.....</b>	<b>- 55 -</b>
<b>Q6.若双方约定之前报送的某笔交易取消或修改怎么报送？.....</b>	<b>- 55 -</b>
<b>Q7.若出现新开仓交易时的个别交易要素与后来收到的交易确认书里的内容不一致的情况，如何填报？.....</b>	<b>- 56 -</b>

Q8.涉及多腿的香草期权、奇异期权如何报送? ...	- 56 -
Q9.如果期权产品结构为 O (其他), 如何填报? .	- 57 -
Q10.如果标的资产为多资产, 填报时需要注意什么?	- 57 -
Q11.成交文件和持仓文件中哪些字段填报时需要考虑 买卖方向? 填报哪一方的方向? .....	- 58 -
Q12.客户资金表中的客户范围是哪些? .....	- 58 -
Q13.客户资金表中“当日出入金”是站在哪个账户角度的 出入金? .....	- 58 -
Q14.商品 ETF 属于商品类还是权益类? .....	- 59 -
Q15.同一交易确认书包含多笔交易, 是否需要多次上传 该交易确认书? .....	- 59 -
Q16.公司与客户平仓时未签署平仓交易确认书, 而是出 具清算报告, 清算报告是否要上传? .....	- 59 -
Q17.公司与客户签署交易确认书时只加盖单章, 公司并 无必须加盖双章的相关规定, 是否只上传加盖单章的交易确 认书? .....	- 59 -



## 一、信息报送总体要求

### (一) 报告主体

在中国期货业协会完成场外衍生品业务备案的公司。

### (二) 报送范围

报告主体开展的所有场外衍生品业务。

### (三) 报送文件

序号	文件类型	解释	文件格式	命名规则
1	成交文件	某一交易日确认的所有新开仓、取消、平仓、终止等的场外衍生品成交明细	Excel	otctrddata+交易确认日期.xlsm
2	持仓文件	某一交易日未平仓的场外衍生品持仓明细	Excel	otcposdata+持仓日期.xlsm
3	客户资金表	某一交易日与报告主体开展场外衍生品业务的客户（即交易对手方 2）的授信、资金相关信息	Excel	funddata+结算日期.xlsm
4	主协议	某一交易日与对手方签署的主协议	Pdf 或 Word	交易对手方名称+签署日期
5	补充协议	某一交易日与对手方签署的补充协议	Pdf 或 Word	交易对手方名称+签署日期
6	履约担保协议	某一交易日与对手方签署的履约担保协议	Pdf 或 Word	交易对手方名称+签署日期
7	交易确认书	某一交易日确认的所有新开仓、平仓、终止等的场外衍生品交易确认书	Pdf 或 Word	交易确认书编号+交易确认日期

#### **(四) 报送时限**

**成交文件、持仓文件、客户资金表：**逐日报送，T+1 日下午 14 点前报送 T 日（交易日）信息，T-1 日 16:00 至 T 日 16:00 定义为 T 日，请注意要在 14 点前上报成功，而不是 14 点前点击报送按钮。

**主协议：**原则上主协议签署后的 5 个工作日内（即 T+5）上报双方盖章版的主协议。

**补充协议：**原则上补充协议签署后的 5 个工作日内（即 T+5）上报双方盖章版的补充协议。

**履约担保协议：**原则上履约担保协议签署后的 5 个工作日内（即 T+5）上报双方盖章版的履约担保协议。

**交易确认书：**逐日报送，原则上 T+1 日下午 14 点前报送 T 日的交易确认书（未盖章版或盖章版均可），双方盖章版的交易确认书不得晚于 T+1 月最后一个工作日（含）之前上报。

## **二、成交文件、持仓文件的字段解释及填报要求**

### **(一) 交易对手方相关字段**

#### **1.交易对手方 2 名称**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指签署交易确认书的交易对手方全称，一般情况下与其统一社会信用代码一一对应，勿填写简称。例：若对手方为 XXXX 有限公司，请填写“XXXX 有限公司”，勿填“XXXX”。

若交易对手方为子公司某事业部，需填写子公司名称，而非

某事业部。例：若对手方为 XXXX 有限公司-YYYY 部、XXXX 有限公司-ZZZZ 部等，请填写该公司全称“XXXX 有限公司”。

若交易对手方为产品，只填报产品名称即可，无需按照“产品名称-产品管理人全称”填写。产品名称应与其在中国证券投资基金业协会备案产品时的产品名称一致。

## 2.交易对手方 2 的统一社会信用代码

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指交易对手方营业执照上的统一社会信用代码。请注意填报格式为文本格式，防止统一社会信用代码出现科学计数法的格式。若交易对手方为产品，请填写该产品对应管理人的统一社会信用代码。

## 3.交易对手方 2 的 LEI

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：LEI (Legal Entity Identifier) 指“法人机构识别编码”，是给机构分配的一个编码，用于识别法人机构，功能类似于国内的统一社会信用代码，区别在于统一社会信用代码就像给企业颁布的“身份证”，LEI 编码用于国际交易，正如给企业颁发的“护照”。若交易对手方有 LEI 编码，则填写，若无，则无需填写。

## 4.主协议类型

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：交易双方已签署的主协议类型，如 SAC2019 (中

国证券期货市场场外衍生品交易主协议)、ISDA(国际场外衍生品交易标准协议)、NAFMII(中国银行间市场金融衍生产品交易主协议)等。

### 5.主协议日期

所在文件: 成交文件、持仓文件

字段释义: 指交易双方签署主协议的日期。

### (二) 交易类型相关字段

### 6.交易类型

所在文件: 仅成交文件

字段释义: 指该笔成交的具体类型, 可选项包括 NT、MD、ER、FU、PU、ED。各选项释义如下:

NT(新交易): 表示新开仓的交易。

MD(修改): 先前上报的该笔交易各字段信息均无误, 但是双方约定对交易的内容进行修改, 如展期、名义金额变更、股票除权除息等。

ER(取消): 先前上报的该笔成交尚未生效, 但是交易双方约定取消该笔交易。

FU(完全解约): 通过一笔反向交易平仓。

PU(部分解约): 通过一笔反向交易部分平仓。

ED(终止事件): 根据合约条款, 该笔交易在该时间点结束, 或合约赋予一方或双方终止合约的权利。

填报该字段时还需注意:

(1) 若标的资产价格触及敲出障碍价，合约终止，敲出当日该笔交易按照 ED 进行上报。

(2) 对于提前终止的交易，若以平仓形式提前终止，则填报 FU；若以行权形式提前终止，则填报 ED。

(3) 涉及到个股标的除权除息的情况，成交文件中“交易类型”填报为 MD，其他交易要素按照除权除息后的最新情况进行上报，持仓文件按照最新的信息填报即可。

### **(三) 清算、交易相关字段**

#### **7. 是否中央对手方清算**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：用于标识该笔交易是否在中央对手方清算或计划提交至中央对手方清算。

#### **8. 中央清算平台名称**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：若“是否中央对手方清算”填写 Y，则在这里填写具体的中央清算平台名称。若“是否中央对手方清算”填写 N，则该字段无需填写。中央对手方清算与第三方交易平台不同，中央对手方具有履约担保的作用。例：目前大商所场外交易平台不提供中央对手方清算服务，因此不是中央清算平台，仅作为第三方交易平台。

#### **9. 交易平台**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指该笔交易达成的交易平台。请填写“公司柜台”或第三方交易平台。若通过公司柜台达成交易，填写“公司柜台”这四个字即可，不需要填写公司的具体名称。若通过第三方交易平台达成交易，请填写交易平台的具体名称，如大商所场外交易平台等。

#### **（四）交易编码相关字段**

##### **10.交易确认书编号**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指双方签署的交易确认书的编号。成交文件中，若为平仓或到期终止交易，请填写该笔交易平仓或终止时对应的交易确认书编号。若报告主体在记录平仓或终止交易时未设置新的交易确认书编号，则填写开仓时的交易确认书编号。若报告主体上报数据时未获得交易确认书编号，则无需填写，待获取后在持仓文件中更新。

##### **11.成交编号**

所在文件：仅成交文件

字段释义：指报告主体为每笔成交编制的唯一识别码，此编号应该在报告主体的所有历史成交中具有唯一性，且针对同一笔交易的不同生命周期，成交编号应不同，类似于每笔成交的“身份证号”。也就是说，成交文件中，平仓或到期终止交易对应的成交编号应与该笔交易开仓时的成交编号不同。

##### **12.持仓编号**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指报告主体为每笔持仓编制的唯一识别码，此编号应该在报告主体的所有持仓以及该笔持仓的生命期内具有唯一性，类似于每笔持仓的“身份证号”。也就是说，成交文件中，平仓或终止交易对应的持仓编号应与该笔交易开仓时的持仓编号保持一致。

### **13.多腿编号**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指一笔组合交易涉及多腿时，按照多腿数量从1开始依次编号。若交易仅包含1腿，无需填写多腿编号。若组合交易的某一腿平仓，剩余腿的多腿编号仍要填写原有编号。

## **（五）时间相关字段**

### **14.交易确认日期（开仓）**

所在文件：仅持仓文件

字段释义：双方确认交易正式生成的时间。请注意与上报该笔交易开仓时的交易确认日期保持一致。例：某笔交易于3月1日达成，3月2日上传3月1日成交数据时报送了该笔交易，则该笔交易出现在持仓表时，“交易确认日期（开仓）”应始终为3月1日。

### **15.生效日**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指交易双方确认的该场外衍生品交易合约生效日

期，该日期在该交易生命期内不可以调整。成交文件中，若该笔交易为平仓或到期终止，请填写开仓时的生效日期，请勿填写为平仓或到期终止日期。

### **16.到期日**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指交易双方确认的该场外衍生品交易合约失效日期，提前终止日期不影响到期日。

### **17.提前终止日期**

所在文件：仅成交文件

字段释义：指交易提前终止的生效日期，适用的不完整情形如下：

- (1) 双方协商提前终止；
- (2) 符合双方签署的主协议、补充协议或交易确认书等规定的提前终止条款。

## **(六)产品及标的基本信息相关字段**

### **18.交易对手方 1 方向**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：用于识别交易对手方 1（即风险管理公司）是买方还是卖方、浮动方还是固定方。根据工具类型不同，该字段的允许值不同，具体如下：

针对期权和远期交易：

**B:买方**



S: 卖方

针对互换交易:

P: payer, 即付固定、收浮动方

R: receiver, 即收固定、付浮动方

若该笔交易为全部平仓、部分平仓或终止（即交易类型字段填报 FU、PU 或 ED），填报方方向应与开仓（即交易类型字段为 NT）时方向一致。

### 19. 资产类型

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指该笔交易的标的资产所属的资产大类，包括五个可选项，为 IR、CO、CR、FX、EQ 和 O，分别表示利率、商品、信用、外汇、权益和其他。请按照上述的英文简称格式填报。

挂钩标的为公募基金的，基金合同明确约定利率债投资比例不低于非现金基金资产 80% 的债券基金、债券型基金中基金（FOF）、同业存单基金、货币基金按利率类报送。股票基金、偏股混合型基金、股票型基金中基金（FOF）、偏股混合型基金中基金（FOF）、基金合同明确约定可转债（含可交债）投资比例不低于非现金基金资产 80% 的债券基金、公开募集基础设施基金按权益类报送。其他债券基金按信用类报送。黄金及商品期货 ETF 按商品类报送。其他混合基金、其他基金中的基金（FOF）按其他类报送。

### 20. 工具类型

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指该笔交易所采用的工具种类，包括四个可选项，为 SW、OP、FW、O，分别表示互换（掉期）、期权、远期、其他，共四类。

## 21.标的资产所属板块

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指该笔交易的标的资产所属的板块，请参考《监控中心场外衍生品交易报告库数据报送接口说明》中的“6.场外标的资产分类表”进行填写，按照相应代码填写。表格中未列明的品种，请按照该品种实际所属板块填写，而不是上报为其他。若多标的资产涉及多个品种，且这些品种均属同一个板块，填报该板块即可，无需分号分隔。例：多标的资产均为 BL，填报 BL 即可，无需填报为 BL;BL。

## 22.标的资产品种

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指该笔交易的标的资产所属的品种，请参考《监控中心场外衍生品交易报告库数据报送接口说明》中的“6.场外标的资产分类表”进行填写，按照相应代码填写。填写时请注意：

（1）若标的资产为境内外的场内期货品种，请填写具体的品种代码，勿填写中文名称或合约代码，且在尾部填写交易所后缀（交易所后缀见《监控中心场外衍生品交易报告库数据报送接口说明》中的“5.交易所代码”）。例：大商所豆粕期货，需填写

M.DCE, 而不是 M 或 M2005; 新交所标胶 20 号, 要填写 TF.SG, 而不是 TF; LME 锡, 要填写 SN.LME, 而不是 SN。

(2) 若标的资产为上海黄金交易所的 AU9999、AUTD、AGTD 等品种, 请填写 AU9999.SGE、AUTD.SGE、AGTD.SGE 等, 而不是 AU 或者 AG。

(3) 若标的资产为现货品种, 如螺纹钢现货、热轧卷板现货, 勿填写 RB、HC, 而要填写“螺纹钢现货”、“热轧卷板现货”。若标的资产为现货指数, 请填写现货指数的具体名称, 如“螺纹钢现货指数”。

(4) 若标的资产为多标的, 即涉及多个品种(指数除外, 指数为单标的), 请用**英文分号**分隔开不同品种。若标的资产为同一期货品种的跨月价差, 填写该品种即可, 无需分号分隔。若标的资产为跨品种价差或同一品种的期现价差、内外盘价差, 需用英文分号隔开两个品种。

例: 标的资产对应合约为 RB2005.SHF-RB2010.SHF, 标的资产品种应填写为 RB.SHF;

标的资产对应合约为 RB2005.SHF-HC2005.SHF, 标的资产品种应填写为 RB.SHF;HC.SHF;

标的资产对应合约为 AU2108.SHF-AU9999.SGE, 标的资产品种应填写 AU.SHF;AU9999.SGE;

标的资产对应合约为 PB 粉(PBF)青岛港、日照港均价 -I2101.DCE, 标的资产品种应填写铁矿石现货;I.DCE。

(5) 若标的资产为股票指数，涉及沪深 300、上证 50、中证 500，要区分是现货指数还是股指期货。若为股指期货，标的资产品种请填写交易所代码，即 IF.CFE、IH.CFE、IC.CFE。若为股指现货，标的资产品种填写沪深 300 指数、上证 50 指数、中证 500 指数等。

(6) 若标的资产为商品指数，请填写指数名称，按照单标的的规则填写，勿填写构成指数的各个品种，如大商所猪饲料成本指数，应填写“大商所猪饲料成本指数”，勿填写 C.DCE;M.DCE 或  $0.68C+0.2M$ 。

若标的资产不是大商所猪饲料成本指数，而是用玉米期货和豆粕期货加权平均合成的价格，比如  $0.68C+0.2M$ ，应将该标的视为多标的，需按照上述 (4) 多标的资产的相关要求填写。

### 23. 标的资产对应合约

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指该笔交易的标的资产所属的具体合约。填报时请注意：

(1) 若标的资产对应合约为场内期货合约，请填写合约全称，且在合约尾部填写交易所后缀（交易所后缀见《监控中心场外衍生品交易报告库数据报送接口说明》中的“5.交易所代码”）。如：豆粕 2005 合约，请填写 M2005.DCE，勿填写 M2005 或 2005。

(2) 若标的资产对应合约为境内沪深交易所上市产品，请填写交易所为该合约编制的编码，且在合约尾部填写交易所后缀。

如平安银行股票为 000001.SZ，浦发银行股票为 600000.SH，而不是 000001、600000。

(3) 若标的资产对应合约为多标的，即涉及多个合约（指数除外），要以 A-B、A+B、A+B-C 等形式来报送，如 RB2005.SHF-HC2005.SHF。若多个合约间的系数不是 1: 1，填写该字段时要加上系数，如 PP2005.DCE-3MA2005.CZC。请注意填写该字段时，“+”“-”符号仅用于反映多标的之间的运算关系，其他情况下不能出现“+”“-”符号，比如 Mysteel 杭州 HRB400E 螺纹钢  $\Phi$ 16-25MM 沙钢永钢中天均价，中间的“16-25”应该填写为“16\_25”或“16~25”，而不是“16-25”。

(4) 若标的资产是指数（商品指数或股指），请填写该指数对应的万得代码，按照单标的的规则填写，请勿遗漏交易所后缀。如大商所猪饲料成本指数，应填写 DCEPFCI.DCE，而不是 0.68C+0.2M，沪深 300 指数，应填写 000300.SH、399300.SZ。注意填报文本格式，以免出现诸如“000300.SH”在报送后显示为“300.SH”等类似情况。

(5) 若标的资产不是大商所猪饲料成本指数，而是用玉米期货和豆粕期货加权平均合成的价格，应将该标的视为多标的，需按照上述（3）多标的的相关要求填写，即应按照 0.68C2209.DCE+0.2M2209.DCE 等形式填写。

(6) 若标的资产对应合约为现货或现货指数，请填写详细的标的信息，如 PB 粉（PBF）青岛港日照港均价。

## 24.标的期初价格

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指该笔交易开仓时标的资产的期初价格。填报该字段时请注意：

（1）若标的涉及多资产，则请按照“标的资产对应合约”中的资产顺序，用**英文分号**隔开多个资产的期初价格。若多资产标的中各资产系数不为 1，填写该字段时无需考虑系数。

（2）若“标的期初价格符号”为百分比，标的期初价格请转化为小数填写，例：LIBOR 标的期初价格为 1.5%，在该字段要填写 0.015。

## 25.标的期初价格货币

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“标的期初价格”的币种单位。若标的为多资产且货币单位一致，填写该货币单位即可。若标的为多资产且货币单位不一致，则按照“标的资产对应合约”的资产顺序用**英文分号**隔开多个货币单位。

## 26.标的期初价格符号

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“标的期初价格”的表达方式，包括 1（货币金额）、2（百分比）、3（指数点）、4（其他）四个选项。**货币金额**指用货币进行标价，通常情况下当标的资产为商品类时，标的期初价格符号为货币金额，例：20 人民币或 20 美元。**百分比**

通常出现在标的资产为利率、波动率的情形中，例：LIBOR 标的期初价格为 1.5%，此时需要选择百分比。**指数点**通常出现在标的资产为沪深 300 指数、沪深 300 股指期货等股指类情形中，例：沪深 300 指数期初价格为 3700，此时需要选择指数点。

## 27.平仓或终止时的标的价格

所在文件：仅成交文件

字段释义：指该笔交易平仓或终止时的标的价格。填报时请注意：

(1) 若标的为多资产，则请按照“标的资产对应合约”中的资产顺序，用**英文分号**隔开多个资产的平仓或终止时的价格。若多资产标的中各资产系数不为 1，填写该字段时无需考虑系数。

(2) 该字段对应的货币和价格符号与“标的期初价格”保持一致。

## (七) 期权产品基本信息相关字段

### 28.期权行权时间类型

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指期权买方可以选择行权时间的类型，包括 EU（欧式）、US（美式）、BD（百慕大式）、O（其他）四个选项。**欧式期权**指期权买方仅可以在期权到期时选择是否行权。**美式期权**指期权买方可以在期权到期前（含到期当天）任何一天选择是否行权。**百慕大期权**指期权买方可以在到期日前所规定的一系列时间里选择是否行权。

## 29. 期权权利类型

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指买方可以选择买入或卖出的权利类型，包括 1（看跌）、2（看涨）、3（选择）、9（其他）四个选项。填报时请注意：

（1）香草组合期权的“期权权利类型”要按照拆分后每腿期权的实际类型填报，勿将各腿统一报送为 9（其他）。

（2）当期权产品结构为 SA（雪球期权）或 PA（凤凰期权）时，此处请填写敲入状态时香草期权的“期权权利类型”。

## 30. 行权日

所在文件：仅成交文件

字段释义：指期权买方选择行权的日期。对于欧式期权，请填写交易确认的行权日；对于美式期权，仅当该笔交易行权时填报，填报期权买方选择行权的日期。

## 31. 期权产品结构

所在文件：成交文件、持仓文件

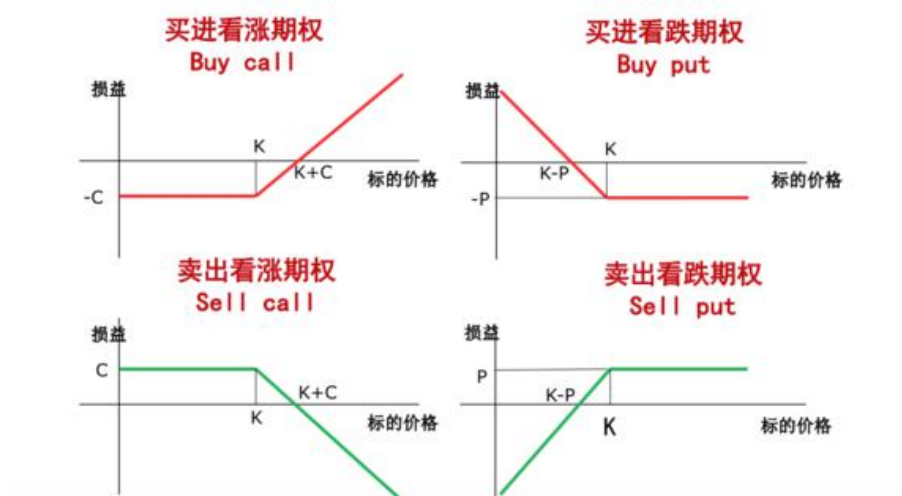
字段释义：指该笔期权交易的结构类型，包括 VA（香草）、AS（亚式）、DI（二元）、RA（区间累计）、SF（单鲨）、DSF（双鲨）、SKI（单障碍敲入）、AC（累计）、GSA（小雪球/保本雪球）、SA（雪球）、PA（凤凰）、O（其他）十一个选项。各产品结构介绍如下：

（1）香草期权（VANILLA，简称 VA）：也称普通期权，指



赋予期权买方在未来一定时间以事先约定的价格买入或卖出标的资产的权利。香草组合期权应按腿报送，如两条腿组成的跨式期权，要拆分为两腿香草期权来报送，两腿期权的产品结构都上报为 VA（香草）即可。

收益结构图：

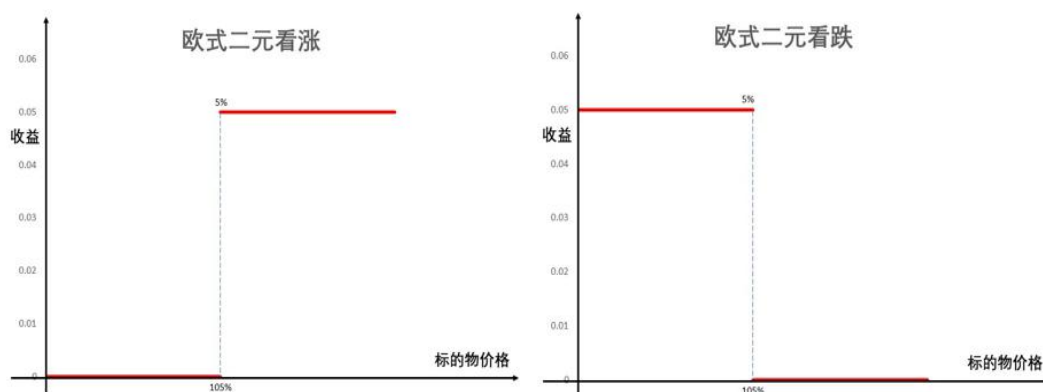


**(2) 亚式 (ASIAN, 简称 AS):** 与香草期权不同的是，亚式期权通常设置观察周期，在观察周期内以一定频率，如逐日观察标的资产的价格，取观察期内标的资产均价做收益计算。收益计算方式分为两种情形：一种是执行价格固定，用观察周期内标的价格的均价计算行权收益；一种是执行价格不固定，把观察周期内标的价格的均价作为执行价格，用行权时的标的价格计算行权收益。亚式期权会涉及各类观察类型，相关信息通过“观察类型”、“观察起始日”、“观察结束日”、“观察周期”、“观察周期乘数”字段进行填写。收益结构图和香草期权一致。

**(3) 二元 (DIGITAL, 简称 DI):** 期权买方所获收益由观

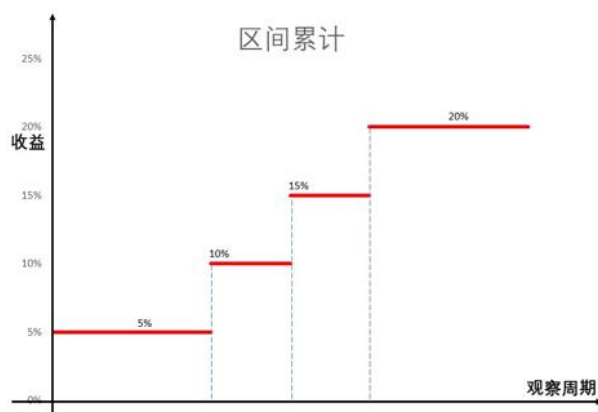
察周期内标的资产价格高于或低于执行价格决定。二元期权会涉及各类观察类型，相关信息通过“观察类型”、“观察起始日”、“观察结束日”、“观察周期”、“观察周期乘数”字段进行填写。

收益结构图：



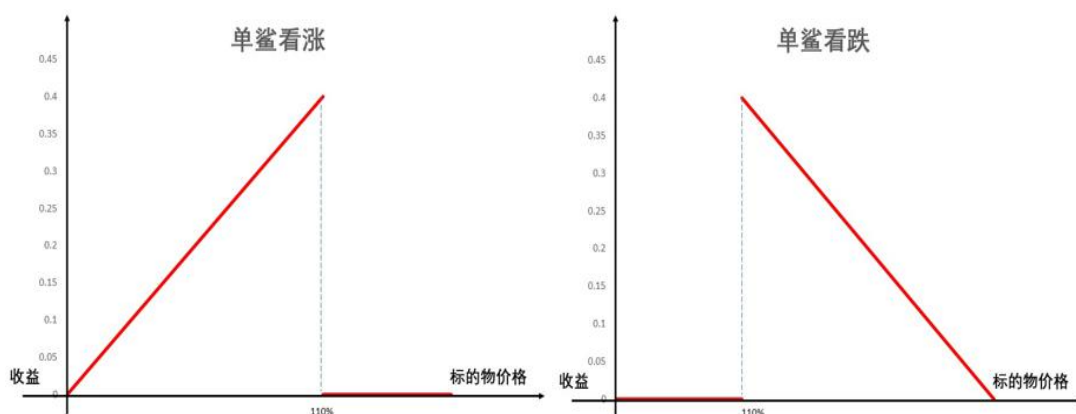
**(4) 区间累计 (RANGE ACCURAL, 简称 RA):** 通常设有不同价格区间,每个区间均设低执行价、高执行价和行权收益。当观察日标的资产价格高于某一区间的低执行价,且低于该区间的高执行价时,期权买方按该区间的行权收益获得收益。合约到期时,期权买方获得各观察日的累计收益。区间累计期权会涉及各类观察类型,相关信息通过“观察类型”、“观察起始日”、“观察结束日”、“观察周期”、“观察周期乘数”字段进行填写。目前,针对区间累计期权只设计了最多三个区间,若开展了三个以上区间的交易,“期权产品结构”请填写 O (其他)。

每个观察日的收益结构图：



**(5) 单鲨 (SINGLE SHARK FIN, 简称 SF):** 指设置了一个敲出障碍价的香草期权, 即当标的资产价格触及障碍价时, 香草期权自动敲出, 合约终止。部分合约约定, 期权敲出后, 期权买方可以获得补偿收益。单鲨期权会涉及各类敲出观察类型, 相关信息通过“观察类型”、“观察起始日”、“观察结束日”、“观察周期”、“观察周期乘数”字段进行填写。

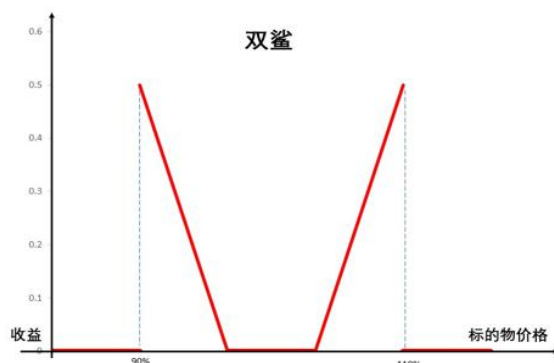
收益结构图:



**(6) 双鲨 (DOUBLE SHARK FIN, 简称 DSF):** 指设有两个敲出障碍价的香草期权, 即当标的资产价格触及任一障碍价时, 香草期权自动敲出, 合约终止。部分合约约定, 期权敲出后, 期

权买方可以获得补偿收益。双鲨期权会涉及各类敲出观察类型，相关信息通过“观察类型”、“观察起始日”、“观察结束日”、“观察周期”、“观察周期乘数”字段进行填写。

收益结构图：



**(7) 单障碍敲入 (SINGLE KNOCK IN, 简称 SKI):** 与香草期权不同的是，单障碍期权结构中，只有当标的资产价格达到一个特定障碍价时，该香草期权才生效。单障碍敲入期权会涉及各类敲入观察类型，相关信息通过“观察类型”“观察起始日”“观察结束日”“观察周期”“观察周期乘数”字段进行填写。收益结构图与香草期权一致。

**(8) 累计期权 (Accumulator, 简称 AC):** 一般指交易商与交易对手方通过场外衍生品的形式达成一系列按周期观察并开展资产买卖的合约，通常由标的资产价格波动情况决定买卖方向及数量（一般有基础交易数量和多倍交易数量区分），可进一步细分为累购期权和累沽期权。以累购期权为例，期权合约通常设有敲出价 (Knock Out Price) 及执行价 (Strike Price)，执行价通常比签约时的标的资产价格有折让，同时设定一定的观察频率

(通常为每日)。合约生效后,当观察日的标的资产价格在执行价和敲出价之间,投资者可以按照执行价买入指定数量的标的资产,当观察日的标的资产价格高于敲出价时,合约终止,当观察日的标的资产价格低于执行价时,投资者需买入指定倍数数量的资产,直至合约完结。

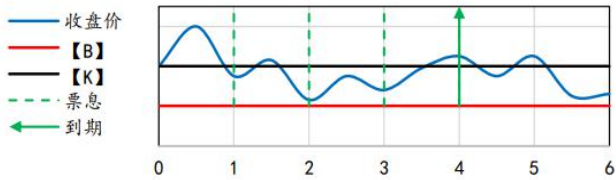
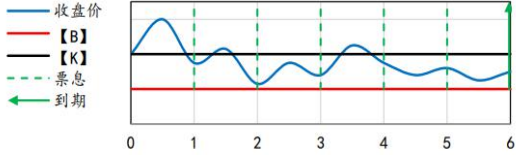
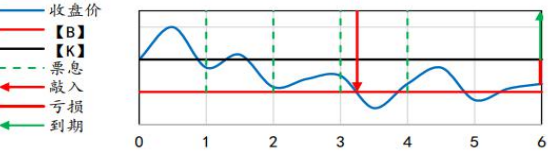
**(9) 看涨自动赎回-小雪球/保本雪球(简称 GSA):** 为二元结构叠加自动赎回方式,只有敲出价,没有敲入价。收益率分两段:敲出发生后获得敲出票息率,否则获得红利票息率(若无,为 0)。敲出票息率请填写在“SA&PA-Coupon 年化收益率”字段,红利票息率请填写在“保底收益”等相关字段。

**(10) 自动敲出可赎回-雪球(SNOWBALL AUTOCALL, 简称 SA):** 为结构化产品。该结构属于路径依赖的自动可赎回期权结构,即标的资产价格波动决定了该期权是否终止、是否会触发一个新的合约以及得到多少收益。通常设有敲入障碍价和敲出障碍价。当标的资产价格达到既定敲出障碍价时,该期权自动终止,期权买方按照 Coupon 收益率获得收益。当标的资产价格波动触及敲入障碍价且后续未触及敲出障碍价,则合约自动触发新的香草期权,并在到期时按照该期权结算收益。当标的资产价格既未触及敲出障碍价,也未触及敲入障碍价时,期权买方按照 Coupon 收益率获得收益。

举例说明如下:

交易对手方买入期限为 6 个月、名义本金为 1000 万元的雪

球期权，敲出观察周期为每月观察，敲入观察周期为每日观察，敲出障碍价（K）为标的期初价格\*100%，Coupon 年化收益率为 21%，敲入障碍价（B）为标的期初价格\*85%，则对手方获得的收益分情形如下：

情景	对手方收益
<p><b>情景一：发生敲出事件</b> 产品于第四个观察日价格触及敲出障碍价</p>  <p>— 收盘价 — 【B】 — 【K】 - - - 票息 → 到期</p>	<p>对手方按照 Coupon 年化收益率获得收益： <math>1000 \text{ 万} * 4/12 * 21\% = 70 \text{ 万}</math></p>
<p><b>情景二：未敲出且未敲入</b> 产品任意观察日内均未触及敲入障碍价和敲出障碍价</p>  <p>— 收盘价 — 【B】 — 【K】 - - - 票息 → 到期</p>	<p>对手方按照 Coupon 年化收益率获得收益： <math>1000 \text{ 万} * 6/12 * 21\% = 105 \text{ 万}</math></p>
<p><b>情景三：未敲出，但发生过敲入</b> 产品在某一交易日低于敲入障碍价（见图中红色箭头），产品有效期内始终未触及敲出障碍价</p>  <p>— 收盘价 — 【B】 — 【K】 ← 敲入 ← 亏损 → 到期</p>	<p>假设到期后标的资产跌幅为 15%，则对手方承担亏损，不获得 Coupon 收益，亏损金额为： <math>1000 \text{ 万} * 15\% = 150 \text{ 万}</math></p>

目前的字段设计可以满足部分变种雪球的填报：一是**保底雪球**，指合约敲入后期权买方可能的赔付有上限，也就是敲入后不是普通香草看涨、看跌，而是价差期权，这种情况可以将敲入后对应的两个行权价分别填写在“执行价格 1”和“执行价格 2”字段中；二是**封闭期雪球**，指敲出观察非常规的每月观察，设

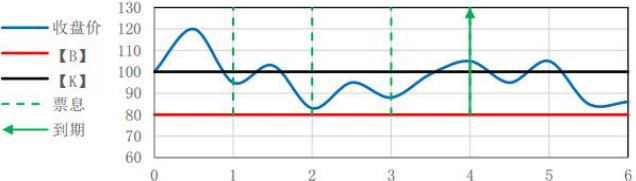
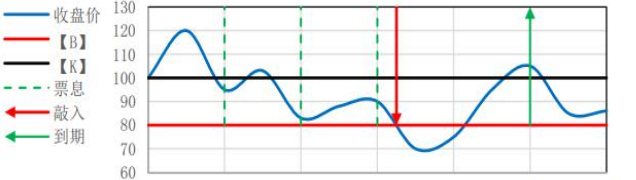
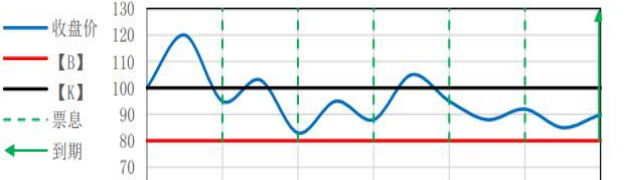
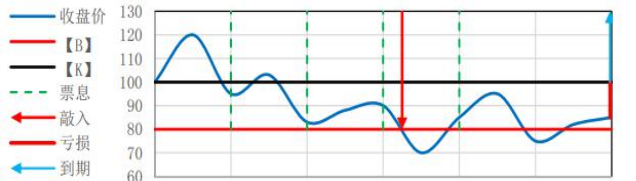
有封闭期，这种情况可以通过“观察类型”“观察起始日”“观察结束日”“观察周期”“观察周期乘数”字段进行填写。若交易为其他类变种雪球，无法通过现有字段将交易要素完全填写，比如 Coupon 年化收益率非固定，而呈阶梯状，这种情况下期权产品结构字段需填报为 O（其他）。

**（11）自动敲出可赎回-凤凰（PHOENIX AUTOCALL，简称 PA）：**为结构化产品。该结构属于自动可赎回期权结构，即标的资产价格波动决定了该期权是否终止、是否会触发一个新的合约以及得到多少收益。与雪球期权不同，凤凰期权通常设有三个障碍价，分别为敲入障碍价、敲出障碍价、Coupon 障碍价。当标的资产价格波动超过敲出障碍价时，期权自动终止，期权买方获得满足 Coupon 障碍价的收益。当标的物价格波动触及敲入障碍价且合约到期时仍未敲出，合约自动触发新的香草期权，期权买方按照该香草期权结算收益且获得满足 Coupon 障碍价的收益。当标的物价格既未触及敲出障碍价，也未触及敲入障碍价时，期权买方获得满足 Coupon 障碍价的收益。故 Coupon 障碍价仅用于决定期权买方在观察日能否获得收益。

举例说明如下：

交易对手方买入期限为 6 个月、名义本金为 1000 万元的凤凰期权，敲出观察周期为每月观察，敲入观察周期为每日观察，敲出价格（K）为标的期初价格\*100%，Coupon 年化收益率为 21%，敲入价格（B）为标的期初价格\*85%，Coupon 障碍价与

敲入价格一致，则对手方获得的收益分情形如下：

情景	对手方收益
<p><b>情景一：发生敲出事件，且存续期内未发生敲入</b> 产品于第四个敲出观察日价格触及敲出障碍价并终止</p> 	<p>对手方获得四期 Coupon 收益： <math>1000 \text{ 万} * 4/12 * 21\% = 70 \text{ 万}</math></p>
<p><b>情景二：发生敲出事件，且存续期内发生敲入</b> 产品在第五个敲出观察日触及敲出障碍价并终止，并在第四个敲出观察日的价格低于敲入障碍价，触发敲入事件，即共有四个敲出观察日的资产价格高于 Coupon 障碍价，期权买方获得四期 Coupon 收益</p> 	<p>对手方获得四期 Coupon 收益： <math>1000 \text{ 万} * 4/12 * 21\% = 70 \text{ 万}</math></p>
<p><b>情景三：未敲出，未敲入</b> 产品在存续期内价格未触及敲入障碍价和敲出障碍价</p> 	<p>对手方按照 Coupon 年化收益率获得收益： <math>1000 \text{ 万} * 6/12 * 21\% = 105 \text{ 万}</math></p>
<p><b>情景四：未敲出，但发生过敲入</b> 产品在某一交易日低于敲入障碍价（见图中红色箭头），产品有效期内始终未触及敲出障碍价</p> 	<p>假设到期后标的资产跌幅为 15%，对手方承担该亏损，并获得符合条件的五期 Coupon 收益，对手方收益为： <math>1000 \text{ 万} * (21\% * 5/12 - 15\%) = -62.5 \text{ 万}</math>，即对手方亏损 62.5 万</p>



目前的字段设计可以满足敲入后不是普通香草看涨、看跌，而是价差期权的变种凤凰的填报，这种变种凤凰情况可以将敲入后对应的两个行权价分别填写在“执行价格 1”和“执行价格 2”字段中。

### 32. 执行价格 1

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指期权买方可以买入或卖出标的资产的价格。填报时请注意：

（1）若“执行价格”为“标的期初价格”的百分比，要转换为绝对数额的形式，计算结果四舍五入保留 4 位小数。例：标的期初价格为 1547 元，执行价为标的期初价格的 117%，则执行价格要填写 1809.9900，而不是 117%。

（2）若“执行价格符号”为百分比，执行价格请以小数填写，例：LIBOR 标的期初价格为 1.5%，在该字段要填写 0.015。

（3）当期权产品结构为 AS（亚式期权），且执行价为观察期内标的价格的均值，则此处无需填写执行价格。

（4）当期权产品结构为 SA（雪球期权）或 PA（凤凰期权）时，此处填写敲入状态时香草期权的执行价格。

（5）若交易涉及多个执行价格，请确保“执行价格 1”<“执行价格 2”<“执行价格 3”。

### 33. 执行价格 2

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指期权买方可以买入或卖出标的资产的价格，填报要求同“执行价格 1”。

### 34. 执行价格 3

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指期权买方可以买入或卖出标的资产的价格，填报要求同“执行价格 1”。

### 35. 执行价格货币

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“执行价格”的币种单位，仅适用于“执行价格符号”为 1（货币金额）的情况。

### 36. 执行价格符号

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“执行价格”的表达方式，可选项同“标的期初价格符号”。

### 37. 观察类型

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：包括 TERMINAL（到期观察）、DISCRETE（离散观察）、CONTINUOUS（连续观察）三个可选项。**到期观察**指仅在到期日当天观察。**连续观察**指在交易生命期内实时观察，包括盘中交易时间。**离散观察**较为常见，指在交易生命期内选择部分时间点进行观察，如每日观察、每月观察等。涉及该字段的“期权产品结构”包括但不限于：

- (1) 期权产品结构为 AS，即亚式期权；
- (2) 期权产品结构为 DI，即二元期权；
- (3) 期权产品结构为 RA，即区间累计期权；
- (4) 期权产品结构为 SF，即单鲨期权；
- (5) 期权产品结构为 DSF，即双鲨期权；
- (6) 期权产品结构为 SKI，即单障碍敲入期权；
- (7) 期权产品结构为 AC，即累计期权；
- (8) 期权产品结构为 GSA，即小雪球/保本雪球；
- (9) 期权产品结构为 SA，即雪球期权，这里的观察指敲出观察；
- (10) 期权产品结构为 PA，即凤凰期权，这里的观察指敲出观察。

### 38.观察起始日

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指交易确认的观察起始日。涉及该字段的“期权产品结构”包括但不限于：

- (1) 期权产品结构为 AS，即亚式期权；
- (2) 期权产品结构为 DI，即二元期权；
- (3) 期权产品结构为 RA，即区间累计期权；
- (4) 期权产品结构为 SF，即单鲨期权；
- (5) 期权产品结构为 DSF，即双鲨期权；
- (6) 期权产品结构为 SKI，即单障碍敲入期权；

(7) 期权产品结构为 AC，即累计期权；

(8) 期权产品结构为 GSA，即小雪球/保本雪球；(9) 期权产品结构为 SA，即雪球期权，这里的观察指敲出观察；

(10) 期权产品结构为 PA，即凤凰期权，这里的观察指敲出观察。

### 39.观察结束日

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指交易确认的观察结束日。涉及该字段的“期权产品结构”包括但不限于：

(1) 期权产品结构为 AS，即亚式期权；

(2) 期权产品结构为 DI，即二元期权；

(3) 期权产品结构为 RA，即区间累计期权；

(4) 期权产品结构为 SF，即单鲨期权；

(5) 期权产品结构为 DSF，即双鲨期权；

(6) 期权产品结构为 SKI，即单障碍敲入期权；

(7) 期权产品结构为 AC，即累计期权；

(8) 期权产品结构为 GSA，即小雪球/保本雪球；(9) 期权产品结构为 SA，即雪球期权，这里的观察指敲出观察；

(10) 期权产品结构为 PA，即凤凰期权，这里的观察指敲出观察。

### 40.观察周期

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：包括 DAIL（日度）、WEEK（周度）、MNTN（月度）、YEAR（年度）、OTHER（其他）五个可选项，与“观察周期乘数”共同决定标的资产价格的观察频率。例：若为每天观察，则“观察周期”填报 DAIL（日度），“观察周期乘数”填报 1。若观察方式非固定频率观察，比如第一天观察、第十天观察、第三十天观察，则“观察周期”填报 OTHER。涉及该字段的“期权产品结构”包括但不限于：

- （1）期权产品结构为 AS，即亚式期权；
- （2）期权产品结构为 DI，即二元期权；
- （3）期权产品结构为 RA，即区间累计期权；
- （4）期权产品结构为 SF，即单鲨期权；
- （5）期权产品结构为 DSF，即双鲨期权；
- （6）期权产品结构为 SKI，即单障碍敲入期权；
- （7）期权产品结构为 AC，即累计期权；
- （8）期权产品结构为 GSA，即小雪球/保本雪球；
- （9）期权产品结构为 SA，即雪球期权，这里的观察指敲出观察；
- （10）期权产品结构为 PA，即凤凰期权，这里的观察指敲出观察。

#### 41.观察周期乘数

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：与“观察周期”共同决定标的资产价格的观察频率。

例：若为每天观察，则“观察周期”填报 DAIL（日度），“观察周期乘数”填报 1。当“观察周期”填报为 Other 时，该字段无需填写。

涉及该字段的“期权产品结构”包括但不限于：

- （1）期权产品结构为 AS，即亚式期权；
- （2）期权产品结构为 DI，即二元期权；
- （3）期权产品结构为 RA，即区间累计期权；
- （4）期权产品结构为 SF，即单鲨期权；
- （5）期权产品结构为 DSF，即双鲨期权；
- （6）期权产品结构为 SKI，即单障碍敲入期权；
- （7）期权产品结构为 AC，即累计期权；
- （8）期权产品结构为 GSA，即小雪球/保本雪球；
- （9）期权产品结构为 SA，即雪球期权，这里的观察指敲出观察；
- （10）期权产品结构为 PA，即凤凰期权，这里的观察指敲出观察。

#### 42.收益计算方式

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：适用于带有敲出结构的期权，如单鲨期权、双鲨期权、连续观察的二元期权等，包括即期计算和到期计算两个选项。**即期计算**指计算收益时，期限按照合约生效日至事件触发日期计算。**到期计算**指计算收益时，期限按照合约生效日至到期日计算。

### 43. 保底收益

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指双方约定的期权买方在交易终止时一定可以获得的收益。若“保底收益符号”为 2（即百分比），请填写该字段时统一转化为年化利率。若交易涉及到参与率，该字段要填报未乘以参与率的保底收益，而不是乘以参与率之后的收益。

### 44. 保底收益货币

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“保底收益”的币种单位，仅适用于“保底收益符号”为 1（货币金额）的情况。

### 45. 保底收益符号

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“保底收益”的表达方式，包括 1（货币金额）和 2（百分比）两个可选项。**货币金额**指针对单位数量标的资产，期权买方可以获得的收益。**百分比**表示期权买方按照年化收益率获得收益。针对不同类型的“保底收益符号”，期权买方可获得的总保底收益计算如下：

若“保底收益符号”为 1（货币金额），总保底收益=未平仓实际名义数量\*保底收益。

若“保底收益符号”为 2（百分比），总保底收益=未平仓实际名义金额\*保底收益\*期限调整因子<sup>1</sup>。

<sup>1</sup>实际名义数量和实际名义金额均为乘以参与率和年化系数后的实际值。  
期限调整因子=收益计算天数/一年总天数。

## 46.是否已敲入

所在文件：仅持仓文件

字段释义：用以标识该笔期权是否已经敲入。若已经敲入，请填写 Y（是），否则填报 N（否）。

### （八）亚式期权相关字段

## 47.估值时已观察均值

所在文件：仅持仓文件

字段释义：指对该笔亚式期权估值时所采用的价格均值，根据交易类型不同，相关填报要求也不同，具体如下：

（1）若该亚式期权的执行价格为固定值，标的资产价格取观察期内的均值，则此处填写估值时采用的标的资产价格，该价格对应的货币和价格符号请与“标的期初价格”保持一致。

（2）若该亚式期权的执行价格取观察期内的均值，非固定值，则此处填写估值时采用的执行价格，该字段对应的货币和价格符号请在“执行价格货币”“执行价格符号”填写。

### （九）二元、区间累计期权相关字段

## 48.行权收益 1

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指双方约定的在特定条件下期权买方可以获得的行权收益。若“行权收益符号”为 2（百分比），请填写该字段时统一转化为年化利率。若交易涉及到“保底收益”，请在该字段填报加上保底收益之后的收益。若交易涉及到参与率，该字段要填



报未乘以参与率的行权收益，而不是乘以参与率之后的收益。

(1) 针对二元期权：若“期权权利类型”为看涨，当观察日标的资产价格高于执行价格时，期权买方获得行权收益；若“期权权利类型”为看跌，当观察日标的资产价格低于执行价格时，期权买方获得行权收益。

(2) 针对区间累计期权，请填写标的资产价格在“执行价 1”与“执行价 2”之间时期权买方可以获得的行权收益。

#### **49.行权收益 2**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指合同约定的，当标的资产价格在“行权价 2”与“行权价 3”之间时，期权买方可以获得的行权收益，其他填报要求同“行权收益 1”。

#### **50.行权收益 3**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指合同约定的，当标的资产价格大于“执行价 3”时，期权买方可以获得的行权收益，其他填报要求同“行权收益 1”。

#### **51.行权收益货币**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“行权收益”的币种单位，仅适用于“行权收益符号”为 1（货币金额）的情况。

#### **52.行权收益符号**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“行权收益”的表达方式，包括 1（货币金额）和 2（百分比）两个可选项。**货币金额**指针对单位数量标的资产，期权买方可以获得的收益。**百分比**表示期权买方按照年化收益率获得收益。针对不同类型的“行权收益符号”，期权买方可获得的总行权收益计算如下：

若“行权收益符号”为 1（货币金额），总行权收益=未平仓实际名义数量\*行权收益。

若“行权收益符号”为 2（百分比），总行权收益=未平仓实际名义金额\*行权收益\*期限调整因子<sup>2</sup>。

#### （十）单鲨、双鲨、单障碍敲入期权相关字段

##### 53.障碍价 1

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指合约中约定的第一个障碍价，当观察日标的资产价格触及该障碍价时，发生敲入或敲出事件。填报该字段时请注意：

（1）若“障碍价 1”为“标的期初价格”的百分比，要转换为绝对数额的形式，计算结果保留 4 位小数。例：标的期初价格为 1547 元，障碍价 1 为标的期初价格的 117%，则障碍价 1 要填写 1809.9900，而不是 117%。

（2）该字段对应的币种和价格符号请与“执行价格”保持一

<sup>2</sup>实际名义数量和实际名义金额均为乘以参与率和年化系数后的实际值。  
期限调整因子=收益计算天数/一年总天数。

致。

#### 54.障碍价 1 触碰方向

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：用以标识触碰“障碍价 1”的方向，包括 UP（向上）和 DOWN（向下）两个选项。向上指当观察日标的资产价格大于“障碍价 1”时触发敲入或敲出事件。向下指当观察日标的资产价格小于“障碍价 1”时触发敲入或敲出事件。

#### 55.障碍价 1 类型

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：用以表示“障碍价 1”的具体类型，包括 OUT（敲出）和 IN（敲入）两个选项，敲出指触及障碍价格后该合约作废，敲入指触及障碍价格后该合约才生效。

#### 56.障碍价 2

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指合约中约定的第二个障碍价，填报要求同“障碍价 1”，且障碍价 1 < 障碍价 2。

#### 57.障碍价 2 触碰方向

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：用以标识触碰“障碍价 2”的方向，可选项及解释同“障碍价 1 触碰方向”。

#### 58.障碍价 2 类型

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：用以表示“障碍价 2”的具体类型，可选项及解释同“障碍价 1 类型”。

### **59.补偿收益 1**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指合约中约定的触碰“障碍价 1”的补偿金额，与“补偿收益符号”共同决定了期权敲出或未敲入时期权买方可以获得的收益。若“补偿收益符号”为 2（百分比），请填写该字段时统一转化为年化利率。若交易涉及到“保底收益”，请在该字段填报加上保底收益之后的收益。若交易涉及到参与率，该字段要填报未乘以参与率的补偿收益，而不是乘以参与率之后的收益。

### **60.补偿收益 2**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指合约中约定的触碰“障碍价 2”的补偿金额，与“补偿收益符号”共同决定了期权敲出或未敲入时期权买方可以获得的收益。填报要求同“补偿收益 1”。

### **61.补偿收益货币**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“敲出收益 1”和“敲出收益 2”的币种单位，仅适用于“敲出收益符号”为 1（货币金额）的情况。

### **62.补偿收益符号**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“补偿收益 1”和“补偿收益 2”的表达方式，包

括 1（货币金额）和 2（百分比）两个可选项。**货币金额**指针对单位数量标的资产，期权买方可以获得的收益。**百分比**表示期权买方按照年化收益率获得收益。针对不同类型的补偿收益符号，期权买方可获得的总补偿收益计算如下：

若“补偿收益符号”为 1（货币金额），总补偿收益=未平仓实际名义数量\*补偿收益。

若“补偿收益符号”为 2（百分比），总补偿收益=未平仓实际名义金额\*补偿收益\*期限调整因子<sup>3</sup>。

### （十一）雪球、凤凰期权相关字段

#### 63.SA&PA-敲入障碍价

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：当标的资产价格在敲入观察日触及该障碍价时，发生敲入事件。填报该字段时请注意：

（1）若“SA&PA-敲入障碍价”为标的期初价格的百分比，要转换为绝对数额的形式，计算结果保留 4 位小数。例：标的期初价格为 2000 元，敲入障碍价为标的期初价格的 70%，则敲入障碍价要填写 1400，而不是 70%。

（2）该字段对应的币种和价格符号请与“执行价格”保持一致。

#### 64.SA&PA-敲入观察期

所在文件：成交文件、持仓文件

<sup>3</sup>实际名义数量和实际名义金额均为乘以参与率和年化系数后的实际值。  
期限调整因子=收益计算天数/一年总天数。

字段释义：指判断期权是否为敲入状态的观察频率，包括 DAIL（日度）、WEEK（周度）、MNTN（月度）、YEAR（年度）、五个选项，多为每日观察。

#### **65.SA&PA-敲出障碍价**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：当标的资产价格在敲出观察日触及该障碍价时，发生敲出事件。填报要求同“SA&PA-敲入障碍价”。

#### **66.SA&PA-Coupon 障碍价**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：当标的资产价格在收益计算观察日未触及该障碍价时，期权买方可以获得 Coupon 收益。填报要求同“SA&PA-敲入障碍价”。

#### **67.SA&PA-Coupon 年化收益率**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指计算买方可以获得 Coupon 收益的年化收益率。若交易涉及到“保底收益”，请在该字段填报加上保底收益之后的收益。若交易涉及到参与率，该字段要填报未乘以参与率的 Coupon 年化收益率，而不是乘以参与率之后的收益。

### **（十二）远期交易相关字段**

#### **68.远期价格**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：开仓时双方约定的远期买卖标的资产的价格。

## 69.远期价格货币

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“远期价格”的币种单位，仅适用于“远期价格符号”为1（货币金额）的情况。

## 70.远期价格符号

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“远期价格”的表达方式，可选项及相应解释同“标的期初价格符号”一致。

### （十三）互换交易相关字段

## 71.固定收益

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：填写互换中约定的收固定、付浮动方所获得的固定收益。

## 72.固定收益货币

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指固定收益的币种单位，仅适用于“固定收益符号”为1（货币金额）的情况。

## 73.固定收益符号

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指“固定收益”的表达方式，包括1（货币金额）和2（百分比）两个可选项。**货币金额**指针对单位数量标的资产，R方（即付浮动、收固定方）可以获得的固定收益。**百分比**表示

R方按照年化收益率获得固定收益。针对不同类型的固定收益符号，R方可获得的总固定收益计算如下：

若“固定收益符号”为1（货币金额），总固定收益=未平仓实际名义数量\*固定收益。

若“固定收益符号”为2（百分比），总固定收益=未平仓实际名义金额\*固定收益\*期限调整因子<sup>4</sup>

#### 74.浮动方向

是否必填：当“工具类型”为SW（互换或掉期）时，必填

字段释义：指R方（收固定、付浮动方）的看涨、看跌方向。

#### 75.支付周期

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：包括DAIL（日度）、WEEK（周度）、MNTH（月度）、YEAR（年度）、TERM（到期支付）、Other（其他）六个可选项，与“支付周期乘数”共同决定何时双方进行收益支付。例：交易双方约定每两月进行一次支付，则“支付周期”填报MNTH，“支付周期乘数”填报2。

#### 76.支付周期乘数

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：与“支付周期”共同决定何时双方进行收益支付。若双方约定到期一次性支付，则无需填写该字段。

<sup>4</sup>实际名义数量和实际名义金额均为考虑了参与率和年化系数后的实际值。  
期限调整因子=收益计算天数/一年总天数。



## (十四) 名义金额、名义数量相关字段

### 77. 初始名义金额

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：应等于“标的期初价格\*初始名义数量”的绝对值，报送该字段时无需报送实际名义金额(实际名义金额指在初始名义金额基础上乘以参与率和年化系数后的结果)。

例：双方开展了标的为 AU1912，3 个月到期的欧式看涨期权交易，行权价格 270，标的期初价格 268，参与率 50%，双方按名义金额 1340000 元确认成交，为年化名义金额，则应报送初始名义金额=1340000，无需报送  $1340000*50%*(3/12)=167500$ 。

### 78. 交易名义金额

所在文件：仅成交文件

字段释义：交易名义金额等于交易名义数量\*开仓时标的期初价格。若该笔交易为新开仓或取消交易(即“交易类型”为 NT、ER)，则“交易名义金额”与“初始名义金额”相等，若该笔交易为平仓或终止(操作类型为 FU、PU、ED)，则“交易名义金额”小于等于“初始名义金额”。其余填报规则与“初始名义金额”一致。

### 79. 已平仓总名义金额

所在文件：仅持仓文件

字段释义：指该交易累计已平仓的名义本金。其中，每次平仓的名义本金=平仓名义数量\*开仓时标的期初价格。持仓文件中的“初始名义金额”与“已平仓总名义金额”的差值为持仓名义

金额，请确保“初始名义金额”大于“已平仓总名义金额”。其余填报规则与“初始名义金额”一致。

**字段 77-79 在填报还需注意以下几种情况：**

(1) 计算名义金额时统一采用“标的期初价格”。涉及组合期权分腿报送的情况，填报名义金额时不考虑权重。

例：对于一个 2 腿组合期权，标的期初价格为 268、标的为 AU1912、数量为 5 手，一腿为买入方向、行权价格为 270 的欧式看涨期权，另一腿为卖出方向、行权价格为 275 的欧式看涨期权。填报上述交易时，请分成两条成交记录报送，腿 1 和腿 2 的初始名义金额均等于  $5*1000*268$ ，而不是  $5*1000*268/2$ 。

(2) 涉及多标的资产交易，上报时需要对应“标的资产对应合约”字段的资产顺序填写各资产的名义金额并用**英文分号**隔开。我们将采用各标的资产名义金额中的最大值计为该笔交易的名义金额。

例：对于标的为 PP2009-3\*MA2009 的价差期权，组合的初始名义数量为 1000 吨，标的期初价格为 8000;2300，则“初始名义金额”为  $1000*8000;1000*3*2300$ ，即 8000000;6900000。

(3) 如计价货币非人民币，都要按照转换为人民币的金额进行上报，汇率填写在“外汇兑人民币期初汇率”字段。

(4) 请不要以带千分位符的格式进行填写。

## **80. 外汇兑人民币期初汇率**

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义:将开仓时外币名义金额以及权利金转换为人民币时所使用的汇率。请填写开仓时人民银行公布的人民币外汇即期报价。在同一笔交易的生命期内,该汇率是一个固定值,以保证该交易存续期内以人民币计价的名义金额和开仓权利金是一个定值。

### 81.初始名义数量

所在文件:成交文件、持仓文件

字段释义:指开仓时交易确认书上约定的交易标的资产的数量。若无标明对应标的资产数量,则按照初始名义金额/标的期初价格计算。报送该字段时无需报送实际名义数量(实际名义数量指在初始名义数量基础上乘以参与率和年化系数后的结果)。

例:双方开展了标的为AU1912,3个月到期的欧式看涨期权交易,行权价格270,标的期初价格268,参与率为50%,双方按名义金额1340000确认成交,为年化名义金额,则应报送初始名义数量 $=1340000/268=5000$ 克,无需报送实际初始名义数量 $1340000*50%*(3/12)/268=625$ 克。

### 82.交易名义数量

所在文件:仅成交文件

字段释义:指该笔交易对应的名义数量,等于交易名义金额/开仓时标的期初价格。其余填报规则与“初始名义数量”一致。

### 83.已平仓总名义数量

所在文件:仅持仓文件

字段释义：指该合约累计已平仓的名义数量，等于已平仓总名义金额/开仓时标的期初价格。其余填报规则与“初始名义数量”一致。

**字段 81-83 在填报还需注意以下几种情况：**

(1) 涉及组合期权分腿报送的情况，填报名义数量时不考虑权重。

例：对于一个 2 腿组合期权，标的期初价格为 268、标的为 AU1912、数量为 5 手，一腿为买入方向、行权价格为 270 的欧式看涨期权，另一腿为卖出方向、行权价格为 275 的欧式看涨期权。填报上述交易时，请分成两条成交记录报送，腿 1 和腿 2 的初始名义数量均为 5000 克，而不是 2500 克。

(2) 涉及多标的资产交易，上报时需要对应“标的资产对应合约”字段的资产顺序填写各资产的名义数量并用英文分号隔开。若多资产标的的组合公式中某标的系数不为 1，则该标的资产的初始名义数量需要用组合的名义数量乘以系数的绝对值。举例：对于标的为 PP2009-3\*MA2009 的价差期权，组合的初始名义数量为 1000 吨，则“初始名义数量”填报 1000;3000。

(3) 若出现如大商所鸡蛋期货等数量单位与计价单位中的数量单位不一致的情况，名义数量需按照计价单位中的数量单位进行上报。例：交易标的为大商所鸡蛋期货，计价单位为元/500kg，数量为 10 吨，则在上报“初始名义数量”时要报为 20，“数量单位”上报为 500kg。

(4) 请不要以带千分位符的格式进行填写。

#### 84.数量单位

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：表示数量的计量单位，包括吨、克、千克、500 千克、桶、股、盎司、磅、元/指数点、其他十个选项。填报时请注意：

(1) 若交易标的资产为鸡蛋期货，“数量单位”要与报价单位中的数量保持一致，即“数量单位”填报为 500 千克。

(2) 若标的资产为沪深 300 等股票指数或股指期货，“数量单位”填报为元/指数点。

#### 85.是否为年化名义金额

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：用以识别该笔交易的名义金额是否为年化的名义金额。请以 Y 或 N 填报，若为年化交易请填写 Y，若不是请填写 N，勿以中文形式填报。请注意此处的是否年化是针对名义金额的，不是针对收益率的年化。

例：双方开展了一笔互换交易，固定收益按照年化利率计算，浮动收益按照标的期末价格较期初价格涨跌幅与名义数量乘积计算，这种情况下年化是针对收益率，而不是名义金额，所以无需上报为年化名义金额。

例：双方开展了一笔看涨期权交易，标的为 AU9999，期限为 45 天，标的期初价格为 360 元/克，执行价格为 365 元/克，

名义数量为 5,000 千克，名义金额为 18 亿元（ $360 \times 5,000 \times 1,000 / 100,000,000$ ），到期时标的价格为 370 元/克，双方按照  $5,000 \times 1,000 \times (370 - 365) \times 45 / 365$  结算，这种情况下名义数量 5,000 千克、18 亿元均考虑了年化，因此需要上报为年化名义金额。

## 86. 参与率

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：通常出现在理财产品里嵌套期权的交易中，指该结构化理财产品投资于衍生品的规模与该产品总规模的比值。该字段通常用于计算实际名义金额。一般情况下填报小于等于 1 的数，请勿填为百分比形式。如参与率为 25%，要填写 0.25，而不是 25 或 25%。如不涉及参与率概念，填报 1 即可。

例：交易双方开展了标的为 AU1912、3 个月到期的欧式看涨期权，参与率为 50%，初始名义金额为 134 万元，非年化交易，则实际名义金额为  $134 \text{ 万元} \times 50\% = 67 \text{ 万元}$ 。

## （十五）估值相关字段

### 87. 合约估值时标的价格

所在文件：仅持仓文件

字段释义：指当日对该笔交易进行估值时采用的标的资产最新价格，请注意不是该笔交易开仓时的价格。若标的涉及多个资产，则通过英文分号将各个标的资产价格分隔开，并按照“标的资产对应合约”字段的资产顺序填写。该字段对应的货币和价

格符号与“标的期初价格”保持一致。期权、远期、互换等各类交易均需报送该字段。

### 88. 合约价值

所在文件：仅持仓文件

字段释义：指未完成合同的现值，即出售当前持仓合约需收取的价格。请勿填写单价，且考虑买卖方向，填报交易对手方 1（即风险管理公司）角度的合约价值。也就是说，假设对当前持仓进行平仓，如果交易对手方 1 需要向交易对手方 2 支付，则合约价值为负，反之，交易对手方 2 需要向交易对手方 1 支付，则合约价值为正。若合约价值涉及外币估值，请用估值时的汇率转化为人民币。

例：风险管理公司卖出一笔期权，该期权最新估值为 10 元/吨，初始名义数量为 100 吨，非年化，未有过平仓，则该字段要填写总估值-1000，而不是 10 或 1000。

### 89. 估值方法

所在文件：仅持仓文件

字段释义：指报告方用于估值的依据和方法，包括 M（按市值计价）、O（按模型计价）、C（中央对手方估值）三个选项。按市值计价指估值所用参数全部来自活跃市场（如场内市场），参数取值较为公允。按模型计价指估值所用参数至少有一个是不可观测的，通常取自模型或经验判断。中央对手方估值指估值结果由第三方中央对手方计算。

## 90.估值波动率

所在文件：仅持仓文件

字段释义：指期权估值时使用的隐含波动率，若标的包含多个资产，则对应“标的资产对应合约”的资产顺序填写各资产的估值波动率，并以英文分号隔开。

## 91.一年有效天数

所在文件：仅持仓文件

字段释义：描述估值波动率的测度，即估值时是采用日历日波动率还是交易日波动率。若一年有效天数为 365（日历日），则在其他因素不变的情况下，期权的价格每天都有衰退。若一年有效天数为 245（交易日），则在其他因素不变的情况下，期权的价格每过一个交易日才会衰退。

## 92.Delta

所在文件：仅持仓文件

字段释义：代表标的上涨一个报价单位时，持仓合约总价值的变动相当于多少数量标的资产的变动。数学公式为： $\Delta = \partial c / \partial S$ ， $c$  为合约价值（指合约总价值，非合约单价）， $S$  是标的合约价格。期权、远期、互换等各类交易均需报送该字段。

## 93.Gamma

所在文件：仅持仓文件

字段释义：代表标的上涨一个报价单位时，Delta 的变动量。数学公式为： $\Gamma = \partial \Delta / \partial S$ 。其中， $S$  为标的合约价格。



## 94.Vega

所在文件：仅持仓文件

字段释义：代表估值时的隐含波动率上升 1%时，期权合约总价值的变动量。数学公式为： $Vega = \partial c / (\partial \sigma * 100)$ ，c 为合约价值（指合约总价值，非合约单价），sigma 是期权合约隐含波动率的绝对值。例：隐含波动率为 10%，这里的 sigma 指 0.1，而不是 10。

## 95.Theta

所在文件：仅持仓文件

字段释义：代表时间衰退 1 个有效日期时，期权合约总价值的变动量。数学公式为： $Theta = \partial c / (\partial t * \text{一年有效天数})$ ，c 为合约价值（指合约总价值，非合约单价），t 是年化的时间。

## 96.Rho

所在文件：仅持仓文件

字段释义：代表无风险利率上涨 1%时，期权合约总价值的变动量。数学公式为： $Rho = \partial c / (\partial r * 100)$ ，c 为合约价值（指合约总价值，非合约单价），r 是年化利率的绝对值。例：无风险利率为 4%，这里的 r 要填报 0.04，而不是 4 或 4%。

## 97.Delta cash

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指 Delta\*合约估值时标的价格，如涉及外币，需要用估值时的汇率转化为人民币。针对成交文件，仅当该笔交易

为当日新开仓交易（即交易类型为 NT）时填写。

### 98.Gamma cash

所在文件：仅持仓文件

字段释义：指 Gamma\*合约估值时标的价格，如涉及外币，需要用估值时的汇率转化为人民币。

### 填报 90、92-98 字段时还需注意：

（1）希腊字母的计算都是交易对手方 1（即风险管理公司）角度，勿填报为交易对手方 2 的角度。请不要填报为单位数量的希腊字母值，而应该是单位数量的希腊字母值\*未平仓实际名义数量（例 1、例 2）。

例 1：交易对手方 1 买入标的为 RB2101 的看涨期权，未平仓名义数量为 1000 吨。通过模型计算，单位数量 Delta 为 0.35、单位数量 Gamma 为 0.03。此处 Delta 字段应填报为 350（ $0.35 * 1000$ ），意味着此时交易对手方 1 若在场内卖出 350 吨，即 35 手 RB2101，会实现 delta 中性，勿填报 35 或 0.35。Gamma 字段应填报为 30（ $0.03 * 1000$ ）。

例 2：交易对手方 1 买入 500 吨标的为 JD2101 的看涨期权，该品种报价单位为元/500 千克，相应数量单位应为 500 千克。若该合约未平仓名义数量为 500 吨，未平仓名义数量应填报 1000（ $500000/500$ ）。通过模型计算，单位数量 Delta 为 0.35，则 Delta 字段应填报为 350（ $0.35 * 1000$ ）。

(2) Greeks 代表当前持仓的实际风险敞口，即是已经乘以参与率和年化系数的实际值。

(3) 针对 Delta、Gamma 和 Vega，当交易涉及多个标的资产，根据公司实际定价模型进行填报。若公司将资产组合看作一个新的标的，则估值波动率、Delta、Gamma、Vega、Delta cash、Gamma cash 分别只有一个值。若公司把各个资产分开处理，则每个资产都有对应的估值波动率、Delta、Gamma、Vega、Delta cash、Gamma cash，需要将多个希腊字母值用英文分号隔开，并按照“标的资产对应合约”中的资产顺序填写（例 3）。

例 3：交易对手方 1 买入挂钩标的为 RB2101.SHF-HC2101.SHF 期权，组合未平仓数量为 1000 份，每份组合包括 1 吨螺纹钢、1 吨热轧卷板。通过模型计算，RB2101 对应的单位数量 Delta 为 0.5，HC2101 对应的单位数量 Delta 为 0.3，则在 Delta 字段需填报为 500;300。

(4) 针对挂钩多标的资产的交易，若报告主体把各个标的资产分开处理，即每个标的都有对应的 Gamma，在填报 Gamma 时还需要在各标的 Gamma 数值后增加 Cross Gamma 数值，用英文分号隔开，Gamma cash 无需增加。若交易挂钩三个标的资产，Cross Gamma 报送顺序按照标的资产对应合约中第一个标的资产和第二个标的资产的 Cross Gamma、第一个标的资产和第三个标的资产的 Cross Gamma、第二个标的资产和第三个标的资产的 Cross Gamma 报送（例 4）。

以挂钩两个标的资产为例，Cross Gamma 计算公式如下：

$$\text{Cross Gamma}(S_1, S_2) = \frac{\partial^2(C)}{\partial S_1 \partial S_2}$$

其中，C 为期权合约价值（注意为合约总价值，不是合约单价）， $S_1$  为第一个标的资产的价格， $S_2$  为第二个标的资产的价格。

如果采用简单差分法计算 Cross Gamma，计算公式如下：

$$\text{Cross Gamma}(S_1, S_2) = \frac{C(S_1 + \Delta S_1, S_2 + \Delta S_2) + C(S_1 - \Delta S_1, S_2 - \Delta S_2) - C(S_1 - \Delta S_1, S_2 + \Delta S_2) - C(S_1 + \Delta S_1, S_2 - \Delta S_2)}{4 \Delta S_1 * \Delta S_2}$$

其中，C 是期权合约价值（注意为合约总价值，不是合约单价）， $S_1$  为第一个标的资产的价格， $S_2$  为第二个标的资产的价格， $\Delta S_1$ 、 $\Delta S_2$  分别是相应标的资产的震荡幅度。

例 4：某笔交易挂钩标的为 2\*JD2101.DCE-0.45\*M2101.DCE-1.3\*C2101.DCE，组合未平仓数量为 1000 份，每份组合包括 2\*500KG 鸡蛋、0.45 吨豆粕、1.3 吨玉米。通过模型计算，JD2101 对应的单位数量 Gamma 为 0.5，M2101 对应的单位数量 Gamma 为 0.3，C2101 对应的单位数量 Gamma 为 0.2，JD2101 和 M2101 的 Cross Gamma 为 0.1，JD2101 和 C2101 的 Cross Gamma 为 0.2，M2101 和 C2101 的 Cross Gamma 为 0.3，则 Gamma 字段应填写 500;300;200;100;200;300。

### 99.无风险利率

所在文件：仅持仓文件

字段释义：指合约估值时所用的无风险利率。

## 100.股息

所在文件：仅持仓文件

字段释义：指合约估值时所用的该标的资产的股息。

### (十六) 结算相关字段

## 101.结算方式

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指双方达成一致的结算方式，包括 C（现金）、P（实物）、O（其他）三个选项。

## 102.最后结算日

所在文件：成交文件、持仓文件

字段释义：指交易双方约定的最后结算日期。

## 103.权利金收支或结算收益

所在文件：仅成交文件

字段释义：若该笔成交为期权交易，请填写开仓权利金总额、平仓期权费总额或行权收益总额。若该笔交易为远期或互换，请在交易平仓或终止时填写结算收益。请注意按交易对手方 1（即风险管理公司）角度带方向填写。若涉及外币，请按最新汇率折算为人民币进行填写。

## 三、常见问题及解答

**Q1.已完成场外衍生品业务备案，尚未开展交易，如何报送数据？**

解答：所有完成场外衍生品业务备案的公司均需报送数据，

若无交易数据或客户资金数据，需要空白报送。空白报送指把成交文件、持仓文件、客户资金表的空白模板按要求命名好后上传。

### **Q2.被暂停新增场外衍生品业务，如何报送数据？**

解答：若公司被暂停新增场外衍生品业务时仍有存续业务，则公司仍要每日报送数据。待存续业务全部完结后，公司应主动向我中心申请关闭用户，用户关闭之后公司无需报送数据，用户关闭之前仍要报送数据。

### **Q3.风险管理公司现货团队开展的场外衍生品交易是否报送？**

解答：若该风险管理公司已完成场外衍生品业务备案，其现货团队与公司自身场外衍生品团队开展的场外衍生品交易应当报送，其现货团队与其他公司场外衍生品团队开展的业务无需报送。若该风险管理公司未完成场外衍生品业务备案，而是作为买方与其他场外交易商开展交易，无需报送。

### **Q4.文件命名有何要求？**

解答：请务必按照如下规则命名：

成交文件：otctrddata+交易确认日期

持仓文件：otcposdata+持仓日期

客户资金表：funddata+结算日期

主协议、补充协议、履约担保协议：交易对手方名称+签署日期

交易确认书：交易确认书编号+交易确认日期

一般情况下，交易确认日期、持仓日期、结算日期应为同一天。例：2022年8月4号报送8月3号的数据，成交文件、持仓文件、客户资金表、交易确认书文件名中的日期都应该为20220803，而不是20220804。

上述“+”号只表示不同类别信息的连接，实际命名时无需有“+”号。

#### **Q5.若发现历史报送数据出现错误怎么办？**

解答：若为成交文件、持仓文件或客户资金表历史数据出现错误，需要报告主体把错误那天的正确数据重新上传，重新上传的表格中包括那天的全部数据，而不是仅包括错误数据。

若为某个或某几个补充协议、交易确认书出现错误，只需要报告主体把错误的补充协议、交易确认书重新上传，无需把当天所有的补充协议或交易确认书重新上传。

我们会对公司上传中的漏报、错报情况进行监测，请认真对待数据报送工作，准确、及时、完整的完成数据上报。

#### **Q6.若双方约定之前报送的某笔交易取消或修改怎么报送？**

解答：如果是双方约定之前报送的某笔交易取消，在报送成交表时，需要在“交易类型”字段填写“ER”，其余字段与原报送信息保持一致，在报送持仓表时，去掉该笔取消的交易即可。如果是双方约定之前报送的某笔交易修改，在报送成交文件时，需要在“交易类型”字段填写“MD”，其余字段填写修改后的

正确信息，在报送持仓文件时，按照最新的情况填写即可，无需追溯修改之前日期的持仓表。

**Q7.若出现新开仓交易时的个别交易要素与后来收到的交易确认书里的内容不一致的情况，如何填报？**

解答:(1)若双方确认是交易确认书上的交易要素填写有误，需要重新出具交易确认书。

(2)若双方确认以交易确认书上的信息为准，则需要成交文件的“交易类型”字段填写“MD”，其余字段填写修改后的正确信息（即交易确认书上的信息），持仓文件按照最新的情况填写即可。

例：8月1日，双方新开仓一笔交易，名义金额为100万，8月2日上午，子公司将该笔交易分别上报在成交文件和持仓文件中，成交文件中该交易的“交易类型”为“NT”，名义金额为100万，8月3日，子公司收到交易确认书后，双方确认名义金额调整为101万，则8月4日，子公司在上报8月3日数据时，需要在成交文件中继续上报该笔交易，“交易类型”上报为“MD”，同时成交文件和持仓文件的名义金额都改为101万元。

**Q8.涉及多腿的香草期权、奇异期权如何报送？**

解答:(1)针对香草组合期权，按“一腿报送一行”上报。

(2)针对“期权产品结构”字段列明的奇异结构（亚式、二元、区间累计、单鲨、双鲨、单障碍敲入、累计、雪球、凤凰），按“一笔报送一行”上报。



(3) 针对“期权产品结构”字段未列明的奇异结构，原则上按“一笔报送一行”上报。

**Q9.如果期权产品结构为 O (其他), 如何填报?**

解答: 该期权产品结构的特有字段无需填报, 但是期权产品基本信息字段, 名义金额、名义数量等相关字段应该准确填报。

**Q10.如果标的资产为多资产, 填报时需要注意什么?**

解答: (1) 股指、商品指数 (例如大商所发布的猪饲料成本指数、蛋鸡养殖利润指数等) 为单资产, 不是多资产;

(2) “标的资产对应合约”字段应清晰表示各标的资产的运算关系, 而不是用英文分号隔开各个合约:

正确示例: RB2209.SHF-HC2209.SHF;

错误示例: RB2209.SHF;HC2209.SHF

(3) “标的资产对应合约”中的“+”“-”符号为多资产的标识符, 因此仅当且仅当标的资产为多标的时, 才可以出现“+”“-”符号:

正确示例: Mysteel 北京 HRB400E 螺纹钢Φ18\_22mm 敬业

错误示例: Mysteel 北京 HRB400E 螺纹钢Φ18-22mm 敬业

(4) 以下字段涉及到多资产时, 需要用英文分号隔开各个标的的数额, 且按照“标的资产对应合约”中的资产顺序填写:

**成交表:** “标的资产品种” “标的期初价格” “标的期初价格货币” “平仓或终止时的标的价格” “初始名义数量” “交易名义数量” “初始名义金额” “交易名义金额” “Delta Cash” 字段;

**持仓表：**“标的资产品种”“标的期初价格”“标的期初价格货币”“初始名义数量”“已平仓总名义数量”“初始名义金额”“已平仓总名义金额”“合约估值时标的价格”“估值波动率”“Delta”“Gamma”“Vega”“Delta Cash”“Gamma Cash”。若公司将多标的视为单标的估值，则“估值波动率”“Delta”“Gamma”“Vega”“Delta Cash”“Gamma Cash”无需用英文分号分割。

**Q11.成交文件和持仓文件中哪些字段填报时需要考虑买卖方向？填报哪一方的方向？**

解答：成交文件中的“权利金收支或结算收益”“Delta Cash”，持仓文件中的“合约价值”“Delta”“Gamma”“Vega”“Theta”“Rho”“Delta Cash”“Gamma Cash”在填报时需要考虑买卖方向，按照交易对手方1（即风险管理公司）的方向填写。

请注意填报名义金额、名义数量相关字段时无需考虑方向。

**Q12.客户资金表中的客户范围是哪些？**

解答：包括以下三类客户：

- （1）当日有成交（包括新开仓、平仓、终止等）的客户；
- （2）当日有持仓的客户；
- （3）有资金或授信信息的客户。

**Q13.客户资金表中“当日出入金”是站在哪个账户角度的出入金？**

解答：是站在客户（即交易对手方2）在风险管理公司的交易账户角度，比如客户购买了一笔期权，向风险管理公司转账一

笔期权费 1000 元，同时当天风险管理公司转账一笔结算款给客户，金额为 500 元，则“当日出入金”为：入金（1000 元）- 出金（500 元）= 500 元。

**Q14. 商品 ETF 属于商品类还是权益类？**

解答：属于商品类，填报时“资产类型”填 CO，“标的资产所属板块”填 COETF。请注意，只有基金最终投向商品期货、现货等才是商品 ETF，比如 512400.SH（有色金属 ETF）投向是有色行业的公司股票，不属于商品 ETF。

**Q15. 同一交易确认书包含多笔交易，是否需要多次上传该交易确认书？**

解答：上传一次即可，上传文件名中的“交易确认书编号”应与结构化数据表中的“交易确认书编号”保持一致。

**Q16. 公司与客户平仓时未签署平仓交易确认书，而是出具清算报告，清算报告是否要上传？**

解答：需要，清算报告视同为平仓交易确认书。

**Q17. 公司与客户签署交易确认书时只加盖单章，公司并无必须加盖双章的相关规定，是否只上传加盖单章的交易确认书？**

解答：这种情况下只需要上传加盖单章的交易确认书即可。